

KEMENTRIAN RISET TEKNOLOGI DAN PENDIDIKAN TINGGI
FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS UNIVERSITAS AIRLANGGA

PROGRAM STUDI : EKONOMI PEMBANGUNAN

DAFTAR No :

ABSTRAK

SKRIPSI SARJANA EKONOMI

NAMA : FARHAN ADITYA

NIM : 041311133105

TAHUN PENYUSUNAN : 2019

JUDUL:

PENGARUH VOLATILITAS NILAI TUKAR TERHADAP EKSPOR: STUDI KASUS DI INDONESIA PERIODE 2002M1-2017M12

ISI:

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis perubahan rezim atau *state* pada volatilitas nilai tukar serta menganalisis pengaruh volatilitas nilai tukar, *terms of trade* dan GDP dunia terhadap ekspor Indonesia. Data yang dianalisis adalah data periode 2002M1-2017M12. Penelitian ini menggunakan pendekatan kuantitatif dengan metode SWARCH untuk melihat perubahan rezim atau *state* pada volatilitas nilai tukar serta menggunakan metode ARDL untuk melihat pengaruh volatilitas nilai tukar, *terms of trade* dan GDP dunia dalam jangka pendek dan jangka panjang.

Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa terdapat perubahan rezim atau *state* pada volatilitas nilai tukar, serta berdasarkan metode ARDL volatilitas nilai tukar tidak memiliki pengaruh terhadap ekspor Indonesia baik dalam jangka pendek maupun jangka panjang. *Terms of trade* berpengaruh negatif terhadap ekspor Indonesia dalam jangka pendek, tetapi tidak memiliki pengaruh pada jangka panjang. GDP dunia berpengaruh positif terhadap ekspor Indonesia dalam jangka pendek maupun jangka panjang.

Kata Kunci : Volatilitas nilai tukar, *terms of trade*, GDP, Ekspor, SWARCH, ARDL.